

# 易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基 金

## 2018 年半年度报告

### 2018 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇一八年八月二十八日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1 重要提示及目录 .....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
2 基金简介 .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
3 主要财务指标和基金净值表现 .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
4 管理人报告 .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	12
5 托管人报告 .....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	13
6.1 资产负债表 .....	13
6.2 利润表 .....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	16
6.4 报表附注 .....	17
7 投资组合报告 .....	36
7.1 期末基金资产组合情况 .....	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	50
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	51
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	51

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	51
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	51
7.12	投资组合报告附注 .....	51
8	基金份额持有人信息 .....	52
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2	期末上市基金前十名持有人 .....	53
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	54
9	开放式基金份额变动 .....	54
10	重大事件揭示 .....	54
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	54
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	54
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4	基金投资策略的改变 .....	55
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	55
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8	其他重大事件 .....	57
11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	58
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	58
12	备查文件目录 .....	59
12.1	备查文件目录 .....	59
12.2	存放地点 .....	59
12.3	查阅方式 .....	59

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达深证成指 ETF
场内简称	深成指 EF
基金主代码	159950
交易代码	159950
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)
基金合同生效日	2017 年 4 月 27 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	19,205,045.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2017 年 5 月 10 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人将采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 内，年化跟踪误差控制在 2% 内。
业绩比较基准	深证成份指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露	姓名	张南	王永民

负责人	联系电话	020-85102688	010-66594896
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-85104666	010-66594942
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-42891（集中办公区）	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		510620	100818
法定代表人		刘晓艳	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号 广州银行大厦 40-43 楼

注：本基金场内注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，场外注册登记机构为易方达基金管理有限公司。

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2018年1月1日至2018年6月30日）
本期已实现收益	-480,708.80
本期利润	-3,190,711.26
加权平均基金份额本期利润	-0.1766
本期加权平均净值利润率	-16.32%

本期基金份额净值增长率	-15.67%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2018 年 6 月 30 日)</b>
期末可供分配利润	-952,809.57
期末可供分配基金份额利润	-0.0496
期末基金资产净值	18,252,235.43
期末基金份额净值	0.9504
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2018 年 6 月 30 日)</b>
基金份额累计净值增长率	-4.96%

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.期末可供分配利润,为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-8.83%	1.68%	-8.90%	1.73%	0.07%	-0.05%
过去三个月	-13.53%	1.31%	-13.70%	1.34%	0.17%	-0.03%
过去六个月	-15.67%	1.34%	-15.04%	1.37%	-0.63%	-0.03%
过去一年	-10.77%	1.14%	-10.92%	1.15%	0.15%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-4.96%	1.09%	-8.09%	1.11%	3.13%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017 年 4 月 27 日至 2018 年 6 月 30 日)



注：1.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为三个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同（第十四部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。

2.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为-4.96%,同期业绩比较基准收益率为-8.09%。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4号文批准，易方达基金管理有限公司（简称“易方达”）成立于2001年4月17日，总部设在广州，在北京、上海、成都、大连等地设有分公司，并全资拥有易方达资产管理有限公司与易方达国际控股有限公司两家子公司。易方达始终坚持在诚信规范的前提下，通过市场化、专业化的运作，为投资人的资产实现持续稳定的保值增值，成为国内领先的综合性资产管理机构，具有较强的综合实力。易方达是国内为数不多的具有基金公司全部业务牌照的公司之一，拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、QFII、RQFII、QDIE、QFLP、基本养老保险基金投资等业务资格，投资业务包括主动权益、固定收益、指数量化、海外投资、多资产投资、另类投资等六大板块，为境内外投资者提供个性化、多样化的投资管理服务。截至2018年6月30日，易方达旗下管理的各类资产规模总计1.3万亿元，服务各类客户总数7580万户，公募基金累计分红超过1000亿元。



## 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理 (助理) 期 限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
成曦	本基金的基金经理、易方达中小板指数分级证券投资基金的基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金的基金经理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理、易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理	2017-04-27	-	10 年	硕士研究生，曾任华泰联合证券资产管理部研究员，易方达基金管理有限公司集中交易室交易员、指数与量化投资部指数基金运作专员、基金经理助理。
刘树荣	本基金的基金经理、易方达中小板指数分级证券投资基金的基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金的基金经理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理	2017-07-18	-	11 年	硕士研究生，曾任招商银行资产托管部基金会计，易方达基金管理有限公司核算部基金核算专员、指数与量化投资部运作支持专员、基金经理助理。

注：1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，成曦的“任职日期”为基金合同生效之日，刘树荣的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 66 次，其中 64 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易；2 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为深证成指，深证成指由深圳证券市场规模大、流动性好、最具代表性的 500 只股票组成，既涵盖市值超千亿的大盘蓝筹如万科 A、美的集团等，也包含中小板、创业板中的小盘成长股，兼具了价值股与成长股的特性，风格较均衡，代表了深交所上市股票的整体走势。本基金主要采取完全复制法投资策略，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

2018 年上半年，国内宏观经济在多重压力下仍保持了较为稳健的增长，2 季度 GDP 同比增长 6.7%，较前值略回落 0.1 个百分点。A 股市场整体下跌，深成指下跌 15.04%。深成指年初开局较好，1 月份上涨 1.1%。2 月初，在中美贸易爆发冲突的担忧下，股票市场出现急速下跌，虽然在 2 月中开始了近一个月的反弹，但伴随着资管新规对股票市场的冲击、债务违约引发的信用债危机、中美之间贸易摩擦扩大的恐慌、股票质押风险加大以及人民币贬值等的不利因素的影响下，市场在二季度呈现加速下跌的态势。深成指中行业占比较大的电子、房地产、传媒行业上半年分别下跌 21%、19%、21%，对指数的负面影响较大，而医药生物、家用电器、食品饮料行业相对抗跌，上半年涨幅分别为 3.1%、0.1%、-6.4%。

基金运作层面，报告期内，本基金严守基金合同认真对待投资者申购、赎回以及成分股调整事项，保障基金的正常运作，基金跟踪误差以及日均偏离度等指标控制在合同规定范围之内。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.9504 元，本报告期份额净值增长率为-15.67%，同期业绩比较基准收益率为-15.04%。本报告期，本基金日跟踪偏离度的均值为 0.03%，年化跟踪误差 0.61%，在合同规定的目标控制范围之内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内金融去杠杆、国外中美贸易摩擦的大环境很难有大的转变，宏观经济存在着一定的下行压力，稳增长依将是政策重点。国内经济在“稳健的货币政策要松紧适度，保持适度的社会融资规模和流动性合理充裕”以及“积极的财政政策要更加积极”的协同配合下，继续着力扩大内需、稳定经济增长与优化经济结构。

A 股市场的结构伴随着互联互通的发展发生了较大变化。一方面，市场对优质股的追捧成为投资的主流方式，另一方面国内外的蓝筹股定价思路开始趋向一致。在互联互通中，北上的资金在沪市集中投资以上证 50 为代表蓝筹股，在深市，更多选择估值盈利比更为合适的特色龙头股票。市场结构的变化叠加前期市场大幅回调加速部分行业的内部分化：龙头企业市占持续扩张，边缘企业生存难度加大。

在经历了上半年大幅调整后，市场风险已有所释放，同时政策基调也逐渐由去杠杆逐步向稳杠杆过渡，前期恐慌情绪得到明显缓解。目前，A 股的整体估值水平明显回落，多数核心指数的估值已经回到低估区域。与此同时，我们观察到市场的投资行为有了以下变化：主流的投资思路已经由短中期的轮动策略（例如：大小盘轮动，价值成长轮动）向买入并长期持有投资策略转移。整个权益市场的投资久期在拉长。当前的指数低估区域也为投资者提供了一个合适的长期窗口。

作为被动投资的基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，致力于为投资者提供分享中国经济增长的优质指数产品。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司首席运营官担任估值委员会主席，主动权益板块、固定收益板块、投资风险管理部、监察部和核算部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

自 2018 年 1 月 30 日至本报告期末，本基金均存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本报告期，本基金均存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

自 2018 年 4 月 3 日至本报告期末，本基金均存在连续六十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。鉴于基金份额持有人数量的下滑主要受市场环境的影响，本基金将继续运作。

本报告期，本基金均存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。鉴于基金资产

净值的下滑主要受市场环境的影响，本基金将继续运作。

## 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,159,161.70	875,347.37
结算备付金		841.30	820.50

存出保证金		402.70	4,871.08
交易性金融资产	6.4.7.2	17,174,923.79	19,720,423.15
其中：股票投资		17,174,923.79	19,715,823.15
基金投资		-	-
债券投资		-	4,600.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		186,892.14	-
应收利息	6.4.7.5	197.70	151.38
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		18,522,419.33	20,601,613.48
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年6月30日</b>	<b>上年度末 2017年12月31日</b>
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	210,236.14
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		7,520.20	8,536.66
应付托管费		1,504.04	1,707.33
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,722.37	3,070.81
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	258,437.29	90,000.00
负债合计		270,183.90	313,550.94
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	19,205,045.00	18,001,380.00
未分配利润	6.4.7.10	-952,809.57	2,286,682.54
所有者权益合计		18,252,235.43	20,288,062.54
负债和所有者权益总计		18,522,419.33	20,601,613.48

注：1.本基金合同生效日为 2017 年 4 月 27 日，2017 年度实际报告期间为 2017 年 4 月 27 日至 2017 年 12 月 31 日。

2. 报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9504 元，基金份额总额 19,205,045.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 4 月 27 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-2,828,648.36</b>	<b>4,392,022.19</b>
1.利息收入		1,981.10	290,628.82
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,980.21	86,617.45
债券利息收入		0.89	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	204,011.37
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-121,993.12	868,388.32
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-238,815.77	226,568.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	37.38	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	116,785.27	641,819.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-2,710,002.46	3,223,117.06
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,366.12	9,887.99
<b>减：二、费用</b>		<b>362,062.90</b>	<b>694,819.03</b>
1. 管理人报酬		48,340.21	128,652.57
2. 托管费		9,667.99	25,730.54
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	6,237.41	419,922.29
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.19	297,817.29	120,513.63
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-3,190,711.26</b>	<b>3,697,203.16</b>

减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-3,190,711.26</b>	<b>3,697,203.16</b>

注：本基金合同生效日为 2017 年 4 月 27 日，上年度可比期间为 2017 年 4 月 27 日至 2017 年 6 月 30 日。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	18,001,380.00	2,286,682.54	20,288,062.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,190,711.26	-3,190,711.26
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,203,665.00	-48,780.85	1,154,884.15
其中：1.基金申购款	1,561,020.00	-11,794.61	1,549,225.39
2.基金赎回款	-357,355.00	-36,986.24	-394,341.24
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	19,205,045.00	-952,809.57	18,252,235.43
项目	上年度可比期间 2017 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	381,001,380.00	-	381,001,380.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,697,203.16	3,697,203.16
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-324,000,000.00	14,716.54	-323,985,283.46
其中：1.基金申购款	87,000,000.00	-2,666.30	86,997,333.70



2.基金赎回款	-411,000,000.00	17,382.84	-410,982,617.16
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	57,001,380.00	3,711,919.70	60,713,299.70

注：本基金合同生效日为 2017 年 4 月 27 日，上年度可比期间为 2017 年 4 月 27 日至 2017 年 6 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]2301号《关于准予易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 381,001,380.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 25,380.00 份基金份额。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的相关规定和指引。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

##### (2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人

未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### （4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25%计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	1,159,161.70

定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	1,159,161.70

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	17,982,649.16	17,174,923.79	-807,725.37
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	17,982,649.16	17,174,923.79	-807,725.37

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	197.16
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	0.36
应收债券利息	-

应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.18
合计	197.70

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,722.37
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,722.37

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	208,437.29
其他应付款	50,000.00
合计	258,437.29

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	18,001,380.00	18,001,380.00
本期申购	1,561,020.00	1,561,020.00
本期赎回（以“-”号填列）	-357,355.00	-357,355.00
本期末	19,205,045.00	19,205,045.00

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,600,948.57	-314,266.03	2,286,682.54
本期利润	-480,708.80	-2,710,002.46	-3,190,711.26
本期基金份额交易产生的	162,839.84	-211,620.69	-48,780.85

变动数			
其中：基金申购款	212,954.38	-224,748.99	-11,794.61
基金赎回款	-50,114.54	13,128.30	-36,986.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,283,079.61	-3,235,889.18	-952,809.57

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2018年1月1日至2018年6月30日	
活期存款利息收入		1,943.18
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		29.19
其他		7.84
合计		1,980.21

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2018年1月1日至2018年6月30日	
卖出股票成交总额		1,919,709.13
减：卖出股票成本总额		2,158,524.90
买卖股票差价收入		-238,815.77

#### 6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2018年1月1日至2018年6月30日	
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额		4,638.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额		4,600.00
减：应收利息总额		1.42
买卖债券差价收入		37.38

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2018年1月1日至2018年6月30日	
股票投资产生的股利收益		116,785.27

基金投资产生的股利收益	-
合计	116,785.27

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1.交易性金融资产	-2,710,002.46
——股票投资	-2,710,002.46
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-2,710,002.46

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	591.51
基金申购费收入	774.61
替代损益收入	-
其他	-
合计	1,366.12

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

## 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	6,237.41
银行间市场交易费用	-
合计	6,237.41

## 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	9,916.99
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	380.00
银行间账户维护费	9,000.00
上市费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
其他	-
合计	297,817.29

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

## 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）	基金托管人
广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司
易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

## 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。



**6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年4月27日（基金合同 生效日）至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	48,340.21	128,652.57
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年4月27日（基金合同 生效日）至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,667.99	25,730.54

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## 6.4.10.4 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	16,255,528.00	84.64%	13,645,790.00	75.80%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

## 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年4月27日（基金合同生效日）至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	1,159,161.70	1,943.18	2,246,715.66	70,784.62

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管,按银行同业利率或约定利率计息。

## 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2017 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额

广发证券	300669	沪宁股份	新股网下 发行	841	9,251.00
------	--------	------	------------	-----	----------

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人股东广发证券发行的股票广发证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

#### 6.4.12 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000008	神州高铁	2018-06-06	重大事项停牌	4.96	2018-08-07	4.46	4,600	33,485.35	22,816.00	-
000415	渤海金控	2018-01-17	重大事项停牌	5.84	2018-07-17	5.26	5,000	32,498.66	29,200.00	-
000426	兴业矿业	2018-06-19	重大事项停牌	7.21	-	-	1,600	12,635.97	11,536.00	-
000540	中天金融	2017-08-21	重大事项停牌	4.87	-	-	12,150	51,938.44	59,170.50	-
000564	供销大集	2017-11-28	重大事项停牌	4.78	2018-07-20	4.29	1,400	9,141.37	6,692.00	-
000566	海南海药	2017-11-22	重大事项停牌	12.89	2018-07-09	11.60	2,600	34,776.73	33,514.00	-
000587	金洲慈航	2018-06-15	重大事项停牌	4.96	2018-07-02	4.46	2,500	18,540.59	12,400.00	-
000666	经纬纺机	2018-03-12	重大事项停牌	18.08	-	-	900	17,380.00	16,272.00	-
000723	美锦能源	2018-03-27	重大事项停牌	5.43	2018-07-31	4.89	2,900	20,039.00	15,747.00	-
000793	华闻传媒	2018-02-01	重大事项停牌	8.40	2018-07-16	7.56	4,900	51,164.61	41,160.00	-
00082	太钢不	2018-	重大事	6.00	-	-	6,500	27,648.50	39,000.00	-

5	锈	04-16	项停牌							
000939	*ST 凯迪	2017-11-16	重大事项停牌	4.99	2018-07-02	4.74	4,900	24,996.27	24,451.00	-
002011	盾安环境	2018-05-02	重大事项停牌	6.40	-	-	1,500	12,007.00	9,600.00	-
002051	中工国际	2018-04-09	重大事项停牌	15.27	-	-	1,260	24,914.22	19,240.20	-
002089	新海宜	2018-04-20	重大事项停牌	6.05	2018-07-20	5.45	2,600	16,176.11	15,730.00	-
002143	印纪传媒	2018-02-02	重大事项停牌	12.09	2018-07-09	10.88	1,000	14,893.00	12,090.00	-
002147	新光圆成	2018-01-18	重大事项停牌	14.76	-	-	1,660	20,676.56	24,501.60	-
002252	上海莱士	2018-02-23	重大事项停牌	19.52	-	-	3,900	79,179.00	76,128.00	-
002310	东方园林	2018-05-25	重大事项停牌	15.03	-	-	4,000	70,006.33	60,120.00	-
002359	北讯集团	2018-05-21	重大事项停牌	19.58	2018-08-21	17.62	1,200	27,117.23	23,496.00	-
002408	齐翔腾达	2018-06-19	重大事项停牌	12.28	-	-	2,300	25,836.66	28,244.00	-
002411	必康股份	2018-06-19	重大事项停牌	28.34	-	-	604	16,299.99	17,117.36	-
002426	胜利精密	2018-06-19	重大事项停牌	3.60	2018-07-03	3.26	5,500	39,034.00	19,800.00	-
002431	棕榈股份	2018-05-30	重大事项停牌	6.71	-	-	2,500	28,614.78	16,775.00	-
002437	誉衡药业	2018-06-11	重大事项停牌	6.20	2018-08-13	5.57	2,300	15,885.99	14,260.00	-
002450	康得新	2018-06-04	重大事项停牌	17.08	-	-	6,300	128,071.27	107,604.00	-
002477	雏鹰农牧	2018-06-14	重大事项停牌	3.31	-	-	4,700	21,582.59	15,557.00	-
002512	达华智能	2018-06-19	重大事项停牌	9.70	-	-	1,300	19,716.42	12,610.00	-
002573	清新环境	2018-06-19	重大事项停牌	11.55	-	-	1,900	35,799.09	21,945.00	-
002602	世纪华通	2018-06-12	重大事项停牌	32.50	-	-	1,000	33,028.19	32,500.00	-
002610	爱康科技	2018-06-05	重大事项停牌	2.10	-	-	10,700	27,802.34	22,470.00	-
002665	首航节能	2018-05-29	重大事项停牌	5.80	-	-	3,300	26,046.50	19,140.00	-

002668	奥马电器	2018-06-15	重大事项停牌	20.10	-	-	683	13,860.14	13,728.30	-
002699	美盛文化	2018-02-05	重大事项停牌	18.76	2018-07-02	16.88	940	14,054.54	17,634.40	-
002716	金贵银业	2018-05-03	重大事项停牌	16.84	-	-	1,000	16,225.07	16,840.00	-
002739	万达电影	2017-07-04	重大事项停牌	52.04	-	-	1,100	59,588.35	57,244.00	-
300072	三聚环保	2018-06-19	重大事项停牌	23.28	2018-07-10	24.00	2,450	91,158.53	57,036.00	-
300090	盛运环保	2018-06-04	重大事项停牌	8.32	2018-07-02	7.49	2,700	24,598.79	22,464.00	-
300118	东方日升	2018-05-07	重大事项停牌	10.80	2018-08-07	9.63	1,371	18,797.65	14,806.80	-
300146	汤臣倍健	2018-01-31	重大事项停牌	16.60	2018-07-31	16.50	2,200	25,601.74	36,520.00	-
300197	铁汉生态	2018-05-28	重大事项停牌	5.37	-	-	3,750	31,608.78	20,137.50	-
300266	兴源环境	2018-02-05	重大事项停牌	19.99	2018-07-02	17.99	1,700	45,544.44	33,983.00	-
300317	珈伟股份	2018-02-05	重大事项停牌	11.90	2018-07-03	10.71	700	10,352.35	8,330.00	-
300324	旋极信息	2018-05-30	重大事项停牌	9.49	-	-	2,574	29,359.49	24,427.26	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的

流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金属股票基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度、对交易对手（包括存款银行）、证券发行人的信用评级进行跟踪，和分散化投资方式防范信用风险。于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2017 年 12 月 31 日：0.02%)。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券、同业存单。

3. 债券投资以全价列示。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00

未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	4,600.53
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	4,600.53

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，期末除 6.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时

变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,159,161.70	-	-	-	1,159,161.70
结算备付金	841.30	-	-	-	841.30
存出保证金	402.70	-	-	-	402.70
交易性金融资产	-	-	-	17,174,923.79	17,174,923.79
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	186,892.14	186,892.14
应收利息	-	-	-	197.70	197.70
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,160,405.70	-	-	17,362,013.63	18,522,419.33
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-



应付管理人报酬	-	-	-	7,520.20	7,520.20
应付托管费	-	-	-	1,504.04	1,504.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,722.37	2,722.37
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	258,437.29	258,437.29
负债总计	-	-	-	270,183.90	270,183.90
利率敏感度缺口	1,160,405.70	-	-	17,091,829.73	18,252,235.43
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	875,347.37	-	-	-	875,347.37
结算备付金	820.50	-	-	-	820.50
存出保证金	4,871.08	-	-	-	4,871.08
交易性金融资产	-	-	4,600.00	19,715,823.15	19,720,423.15
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	151.38	151.38
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	881,038.95	-	4,600.00	19,715,974.53	20,601,613.48
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	210,236.14	210,236.14
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	8,536.66	8,536.66
应付托管费	-	-	-	1,707.33	1,707.33
应付销售服务费	-	-	-	-	-

应付交易费用	-	-	-	3,070.81	3,070.81
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	90,000.00	90,000.00
负债总计	-	-	-	313,550.94	313,550.94
利率敏感度缺口	881,038.95	-	4,600.00	19,402,423.59	20,288,062.54

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转债)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	17,174,923.79	94.10	19,715,823.15	97.18
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	17,174,923.79	94.10	19,715,823.15	97.18

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
	1.业绩比较基准上升 5%	863,578.92	1,005,563.10
	2.业绩比较基准下降 5%	-863,578.92	-1,005,563.10

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1)公允价值

##### (a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b)持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i)各层次金融工具公允价值

于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 15,970,885.87 元，属于第二层次的余额为 1,204,037.92 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 18,891,469.33 元，第二层次 828,953.82 元，无属于第三层次的余额)。

##### (ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	17,174,923.79	92.73
	其中：股票	17,174,923.79	92.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,160,003.00	6.26
8	其他各项资产	187,492.54	1.01
9	合计	18,522,419.33	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	369,775.90	2.03
B	采矿业	142,584.80	0.78
C	制造业	10,987,804.86	60.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	188,301.80	1.03
E	建筑业	292,378.70	1.60
F	批发和零售业	494,040.17	2.71
G	交通运输、仓储和邮政业	150,294.00	0.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,676,735.52	9.19
J	金融业	924,420.63	5.06
K	房地产业	879,398.20	4.82
L	租赁和商务服务业	257,899.96	1.41
M	科学研究和技术服务业	29,434.00	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	172,094.80	0.94
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	240,408.70	1.32
R	文化、体育和娱乐业	343,626.75	1.88
S	综合	25,725.00	0.14
	合计	17,174,923.79	94.10

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000333	美的集团	12,500	652,750.00	3.58
2	000651	格力电器	12,900	608,235.00	3.33
3	000858	五粮液	5,000	380,000.00	2.08
4	002415	海康威视	9,511	353,143.43	1.93

5	000002	万 科 A	10,911	268,410.60	1.47
6	000725	京东方 A	70,000	247,800.00	1.36
7	300498	温氏股份	10,337	227,620.74	1.25
8	000001	平安银行	22,700	206,343.00	1.13
9	002304	洋河股份	1,555	204,638.00	1.12
10	300059	东方财富	10,580	139,444.40	0.76
11	000538	云南白药	1,300	139,048.00	0.76
12	002230	科大讯飞	4,250	136,297.50	0.75
13	002024	苏宁易购	9,500	133,760.00	0.73
14	002008	大族激光	2,400	127,656.00	0.70
15	000568	泸州老窖	2,000	121,720.00	0.67
16	002027	分众传媒	11,828	113,193.96	0.62
17	000338	潍柴动力	12,900	112,875.00	0.62
18	002475	立讯精密	4,994	112,564.76	0.62
19	002142	宁波银行	6,850	111,586.50	0.61
20	002594	比亚迪	2,300	109,664.00	0.60
21	000776	广发证券	8,200	108,814.00	0.60
22	002450	康得新	6,300	107,604.00	0.59
23	002466	天齐锂业	2,070	102,651.30	0.56
24	002236	大华股份	4,500	101,475.00	0.56
25	001979	招商蛇口	5,300	100,965.00	0.55
26	000661	长春高新	414	94,267.80	0.52
27	300003	乐普医疗	2,500	91,700.00	0.50
28	000963	华东医药	1,900	91,675.00	0.50
29	002044	美年健康	4,000	90,400.00	0.50
30	300124	汇川技术	2,726	89,467.32	0.49
31	002456	欧菲科技	5,500	88,715.00	0.49
32	000100	TCL 集团	29,300	84,970.00	0.47
33	000063	中兴通讯	6,500	84,695.00	0.46
34	002422	科伦药业	2,600	83,460.00	0.46
35	002460	赣锋锂业	2,150	82,947.00	0.45
36	000166	申万宏源	17,900	78,223.00	0.43
37	002252	上海莱士	3,900	76,128.00	0.42
38	000423	东阿阿胶	1,400	75,334.00	0.41
39	300015	爱尔眼科	2,300	74,267.00	0.41
40	002202	金风科技	5,817	73,526.88	0.40
41	000895	双汇发展	2,700	71,307.00	0.39
42	300408	三环集团	3,000	70,500.00	0.39
43	300136	信维通信	2,200	67,606.00	0.37
44	000413	东旭光电	10,900	66,054.00	0.36
45	000069	华侨城 A	9,000	65,070.00	0.36
46	300142	沃森生物	3,200	63,936.00	0.35
47	000503	国新健康	2,000	63,560.00	0.35
48	300070	碧水源	4,500	62,685.00	0.34

49	000783	长江证券	11,200	60,816.00	0.33
50	002310	东方园林	4,000	60,120.00	0.33
51	000540	中天金融	12,150	59,170.50	0.32
52	300024	机器人	3,400	59,160.00	0.32
53	300122	智飞生物	1,272	58,181.28	0.32
54	300347	泰格医药	936	57,910.32	0.32
55	002739	万达电影	1,100	57,244.00	0.31
56	300072	三聚环保	2,450	57,036.00	0.31
57	000768	中航飞机	3,600	56,304.00	0.31
58	002241	歌尔股份	5,500	56,045.00	0.31
59	002736	国信证券	6,053	55,082.30	0.30
60	002572	索菲亚	1,700	54,706.00	0.30
61	000977	浪潮信息	2,260	53,901.00	0.30
62	300296	利亚德	4,152	53,477.76	0.29
63	002410	广联达	1,900	52,687.00	0.29
64	000625	长安汽车	5,800	52,200.00	0.29
65	000157	中联重科	12,700	52,197.00	0.29
66	000703	恒逸石化	3,420	50,889.60	0.28
67	000425	徐工机械	12,000	50,880.00	0.28
68	300601	康泰生物	800	49,640.00	0.27
69	000830	鲁西化工	2,900	49,532.00	0.27
70	002405	四维图新	2,400	48,600.00	0.27
71	002049	紫光国微	1,100	48,532.00	0.27
72	002007	华兰生物	1,500	48,240.00	0.26
73	300017	网宿科技	4,400	47,124.00	0.26
74	300144	宋城演艺	2,000	47,000.00	0.26
75	002340	格林美	7,760	46,948.00	0.26
76	002001	新 和 成	2,410	45,693.60	0.25
77	002179	中航光电	1,170	45,630.00	0.25
78	002065	东华软件	5,300	45,580.00	0.25
79	000998	隆平高科	2,406	45,377.16	0.25
80	002050	三花智控	2,365	44,580.25	0.24
81	002038	双鹭药业	1,171	44,486.29	0.24
82	000786	北新建材	2,400	44,472.00	0.24
83	002271	东方雨虹	2,550	43,375.50	0.24
84	002384	东山精密	1,800	43,200.00	0.24
85	300168	万达信息	2,100	42,840.00	0.23
86	002146	荣盛发展	4,900	42,777.00	0.23
87	000623	吉林敖东	2,360	42,432.80	0.23
88	002508	老板电器	1,371	41,980.02	0.23
89	000418	小天鹅A	600	41,610.00	0.23
90	000860	顺鑫农业	1,100	41,250.00	0.23
91	000793	华闻传媒	4,900	41,160.00	0.23
92	000792	盐湖股份	3,800	41,116.00	0.23

93	000728	国元证券	5,500	40,700.00	0.22
94	000513	丽珠集团	920	40,434.00	0.22
95	002294	信立泰	1,086	40,366.62	0.22
96	002311	海大集团	1,900	40,090.00	0.22
97	002714	牧原股份	900	40,014.00	0.22
98	002092	中泰化学	4,100	39,524.00	0.22
99	002081	金螳螂	3,900	39,390.00	0.22
100	002673	西部证券	5,200	39,260.00	0.22
101	002797	第一创业	5,780	39,130.60	0.21
102	002589	瑞康医药	2,865	39,078.60	0.21
103	000825	太钢不锈	6,500	39,000.00	0.21
104	300253	卫宁健康	3,120	38,656.80	0.21
105	002129	中环股份	4,900	38,367.00	0.21
106	000630	铜陵有色	17,200	38,012.00	0.21
107	002217	合力泰	4,600	37,950.00	0.21
108	002078	太阳纸业	3,900	37,791.00	0.21
109	000066	中国长城	5,200	36,972.00	0.20
110	300146	汤臣倍健	2,200	36,520.00	0.20
111	002195	二三四五	8,500	36,380.00	0.20
112	000876	新希望	5,700	36,138.00	0.20
113	000050	深天马 A	2,500	35,550.00	0.19
114	000596	古井贡酒	400	35,512.00	0.19
115	000839	中信国安	7,500	35,475.00	0.19
116	000709	河钢股份	12,000	35,400.00	0.19
117	000581	威孚高科	1,600	35,376.00	0.19
118	002465	海格通信	4,400	35,332.00	0.19
119	002176	江特电机	3,600	34,992.00	0.19
120	002821	凯莱英	400	34,892.00	0.19
121	300383	光环新网	2,600	34,866.00	0.19
122	000826	启迪桑德	1,980	34,610.40	0.19
123	000656	金科股份	7,200	34,560.00	0.19
124	002268	卫士通	1,568	34,229.44	0.19
125	300266	兴源环境	1,700	33,983.00	0.19
126	002439	启明星辰	1,600	33,952.00	0.19
127	002493	荣盛石化	3,275	33,798.00	0.19
128	300166	东方国信	2,280	33,584.40	0.18
129	000566	海南海药	2,600	33,514.00	0.18
130	000690	宝新能源	4,800	33,408.00	0.18
131	300450	先导智能	1,098	33,203.52	0.18
132	002624	完美世界	1,064	32,994.64	0.18
133	300009	安科生物	1,782	32,860.08	0.18
134	002602	世纪华通	1,000	32,500.00	0.18
135	000488	晨鸣纸业	2,500	32,300.00	0.18
136	000983	西山煤电	4,300	32,293.00	0.18



137	000961	中南建设	5,100	32,181.00	0.18
138	002223	鱼跃医疗	1,642	32,002.58	0.18
139	002035	华帝股份	1,300	31,759.00	0.17
140	002352	顺丰控股	700	31,500.00	0.17
141	002127	南极电商	3,350	31,456.50	0.17
142	000060	中金岭南	6,450	31,347.00	0.17
143	000778	新兴铸管	7,300	31,244.00	0.17
144	002019	亿帆医药	1,755	30,975.75	0.17
145	002558	巨人网络	1,300	30,914.00	0.17
146	300170	汉得信息	1,900	30,856.00	0.17
147	300088	长信科技	5,300	30,740.00	0.17
148	002085	万丰奥威	3,260	30,644.00	0.17
149	000999	华润三九	1,100	30,613.00	0.17
150	000932	华菱钢铁	3,600	30,600.00	0.17
151	000039	中集集团	2,300	30,544.00	0.17
152	002110	三钢闽光	1,900	30,457.00	0.17
153	002500	山西证券	4,500	30,330.00	0.17
154	002262	恩华药业	1,500	30,015.00	0.16
155	002221	东华能源	3,069	29,984.13	0.16
156	000997	新大陆	1,900	29,925.00	0.16
157	002371	北方华创	600	29,802.00	0.16
158	300315	掌趣科技	7,100	29,678.00	0.16
159	000750	国海证券	8,300	29,631.00	0.16
160	000938	紫光股份	470	29,422.00	0.16
161	000415	渤海金控	5,000	29,200.00	0.16
162	300433	蓝思科技	1,380	28,952.40	0.16
163	000887	中鼎股份	2,000	28,820.00	0.16
164	002074	国轩高科	2,043	28,724.58	0.16
165	002640	跨境通	1,900	28,538.00	0.16
166	300418	昆仑万维	1,500	28,320.00	0.16
167	000028	国药一致	567	28,293.30	0.16
168	000040	东旭蓝天	2,800	28,280.00	0.15
169	002153	石基信息	975	28,275.00	0.15
170	002408	齐翔腾达	2,300	28,244.00	0.15
171	002470	金正大	4,100	28,208.00	0.15
172	300558	贝达药业	500	27,835.00	0.15
173	300027	华谊兄弟	4,500	27,720.00	0.15
174	002013	中航机电	3,625	27,441.25	0.15
175	002183	怡亚通	4,100	27,265.00	0.15
176	000732	泰禾集团	1,400	27,230.00	0.15
177	002185	华天科技	4,782	26,970.48	0.15
178	000671	阳光城	4,500	26,865.00	0.15
179	000402	金融街	3,300	26,565.00	0.15
180	300413	快乐购	700	26,558.00	0.15

181	300251	光线传媒	2,600	26,468.00	0.15
182	000960	锡业股份	2,200	26,422.00	0.14
183	300628	亿联网络	400	26,364.00	0.14
184	000988	华工科技	1,816	26,241.20	0.14
185	300271	华宇软件	1,465	25,901.20	0.14
186	000681	视觉中国	900	25,830.00	0.14
187	300182	捷成股份	3,400	25,772.00	0.14
188	000930	中粮生化	2,500	25,750.00	0.14
188	002032	苏泊尔	500	25,750.00	0.14
190	000009	中国宝安	5,250	25,725.00	0.14
191	000686	东北证券	4,000	25,640.00	0.14
192	000975	银泰资源	2,520	25,552.80	0.14
193	300014	亿纬锂能	1,451	25,537.60	0.14
194	300073	当升科技	742	25,272.52	0.14
195	002273	水晶光电	1,950	25,096.50	0.14
196	000401	冀东水泥	2,800	24,836.00	0.14
197	002506	协鑫集成	5,300	24,804.00	0.14
198	002385	大北农	6,000	24,780.00	0.14
199	000046	泛海控股	4,312	24,535.28	0.13
200	002147	新光圆成	1,660	24,501.60	0.13
201	000939	*ST 凯迪	4,900	24,451.00	0.13
202	300324	旋极信息	2,574	24,427.26	0.13
203	000559	万向钱潮	3,589	24,405.20	0.13
204	002491	通鼎互联	2,200	24,354.00	0.13
205	002497	雅化集团	2,300	24,242.00	0.13
206	300274	阳光电源	2,700	24,219.00	0.13
207	002138	顺络电子	1,500	24,015.00	0.13
208	300226	上海钢联	400	23,940.00	0.13
209	002030	达安基因	1,530	23,592.60	0.13
210	000528	柳工	2,200	23,562.00	0.13
211	000729	燕京啤酒	3,500	23,555.00	0.13
212	002359	北讯集团	1,200	23,496.00	0.13
213	002373	千方科技	1,800	23,490.00	0.13
214	300316	晶盛机电	1,760	23,390.40	0.13
215	000970	中科三环	2,500	23,375.00	0.13
216	300033	同花顺	600	23,322.00	0.13
217	002281	光迅科技	1,100	23,320.00	0.13
218	000008	神州高铁	4,600	22,816.00	0.13
219	002353	杰瑞股份	1,400	22,750.00	0.12
220	000547	航天发展	2,900	22,649.00	0.12
221	002341	新纶科技	1,700	22,593.00	0.12
222	002023	海特高新	1,800	22,572.00	0.12
223	002610	爱康科技	10,700	22,470.00	0.12
224	300090	盛运环保	2,700	22,464.00	0.12

225	002407	多氟多	1,600	22,432.00	0.12
226	002280	联络互动	3,900	22,308.00	0.12
227	000717	韶钢松山	3,400	22,304.00	0.12
228	300287	飞利信	3,100	22,289.00	0.12
229	000878	云南铜业	2,336	22,285.44	0.12
230	002399	海普瑞	1,000	22,140.00	0.12
231	300010	立思辰	1,800	22,032.00	0.12
232	300188	美亚柏科	1,200	21,960.00	0.12
233	002573	清新环境	1,900	21,945.00	0.12
234	300285	国瓷材料	1,100	21,934.00	0.12
235	002174	游族网络	1,100	21,890.00	0.12
236	002028	思源电气	1,300	21,827.00	0.12
237	000627	天茂集团	3,100	21,762.00	0.12
238	000898	鞍钢股份	3,900	21,723.00	0.12
239	002396	星网锐捷	1,059	21,677.73	0.12
240	000591	太阳能	5,900	21,594.00	0.12
241	300203	聚光科技	841	21,529.60	0.12
242	002368	太极股份	739	21,482.73	0.12
243	002563	森马服饰	1,500	21,450.00	0.12
244	000883	湖北能源	5,200	21,372.00	0.12
245	300133	华策影视	2,000	21,300.00	0.12
246	002366	台海核电	1,492	21,275.92	0.12
247	002372	伟星新材	1,200	21,228.00	0.12
248	000869	张裕A	530	21,125.80	0.12
249	000598	兴蓉环境	5,200	21,112.00	0.12
250	002440	闰土股份	1,800	21,042.00	0.12
251	000831	五矿稀土	1,800	20,952.00	0.11
252	300113	顺网科技	1,200	20,892.00	0.11
253	000807	云铝股份	4,000	20,720.00	0.11
254	300055	万邦达	1,800	20,682.00	0.11
255	000089	深圳机场	2,700	20,655.00	0.11
256	000738	航发控制	1,549	20,648.17	0.11
257	002603	以岭药业	1,471	20,564.58	0.11
258	002168	深圳惠程	2,000	20,560.00	0.11
259	300618	寒锐钴业	160	20,534.40	0.11
260	000516	国际医学	4,266	20,434.14	0.11
261	300036	超图软件	1,000	20,390.00	0.11
262	002597	金禾实业	1,000	20,280.00	0.11
263	000078	海王生物	4,200	20,202.00	0.11
264	002151	北斗星通	785	20,174.50	0.11
265	300115	长盈精密	1,555	20,168.35	0.11
266	300197	铁汉生态	3,750	20,137.50	0.11
267	002831	裕同科技	400	20,000.00	0.11
268	300058	蓝色光标	3,500	19,950.00	0.11

269	300463	迈克生物	800	19,944.00	0.11
270	002583	海能达	2,387	19,931.45	0.11
271	002383	合众思壮	1,200	19,860.00	0.11
272	002004	华邦健康	3,900	19,812.00	0.11
273	002426	胜利精密	5,500	19,800.00	0.11
274	002244	滨江集团	3,800	19,760.00	0.11
275	002701	奥瑞金	3,600	19,656.00	0.11
276	002812	创新股份	400	19,652.00	0.11
277	000799	酒鬼酒	700	19,425.00	0.11
278	002601	龙蟠佰利	1,500	19,395.00	0.11
279	300676	华大基因	200	19,362.00	0.11
280	002051	中工国际	1,260	19,240.20	0.11
281	002180	纳思达	700	19,222.00	0.11
282	002600	领益智造	3,700	19,203.00	0.11
283	002665	首航节能	3,300	19,140.00	0.10
284	002120	韵达股份	360	19,098.00	0.10
285	000848	承德露露	1,800	19,062.00	0.10
286	002916	深南电路	300	19,053.00	0.10
287	002358	森源电气	1,257	18,917.85	0.10
288	002343	慈文传媒	1,007	18,901.39	0.10
289	300355	蒙草生态	3,140	18,871.40	0.10
290	002131	利欧股份	8,935	18,763.50	0.10
291	002709	天赐材料	486	18,730.44	0.10
292	002517	恺英网络	2,600	18,694.00	0.10
293	002191	劲嘉股份	2,500	18,675.00	0.10
294	000981	银亿股份	2,500	18,625.00	0.10
295	002595	豪迈科技	1,071	18,624.69	0.10
296	000935	四川双马	1,200	18,576.00	0.10
297	000917	电广传媒	3,200	18,432.00	0.10
298	002285	世联行	2,926	18,346.02	0.10
299	002152	广电运通	3,100	18,228.00	0.10
300	002555	三七互娱	1,500	18,225.00	0.10
301	300199	翰宇药业	1,266	18,078.48	0.10
302	300308	中际旭创	300	18,012.00	0.10
303	300026	红日药业	4,900	17,885.00	0.10
304	300244	迪安诊断	938	17,831.38	0.10
305	002745	木林森	1,000	17,790.00	0.10
306	300159	新研股份	2,500	17,700.00	0.10
307	300496	中科创达	600	17,682.00	0.10
308	300098	高新兴	2,211	17,643.78	0.10
309	002699	美盛文化	940	17,634.40	0.10
310	000758	中色股份	3,900	17,550.00	0.10
311	300377	赢时胜	1,290	17,531.10	0.10
312	002419	天虹股份	1,200	17,520.00	0.10

313	300367	东方网力	1,400	17,500.00	0.10
314	000902	新洋丰	1,900	17,480.00	0.10
315	002501	利源精制	2,800	17,360.00	0.10
316	000059	华锦股份	2,500	17,225.00	0.09
317	000800	一汽轿车	2,300	17,204.00	0.09
318	300373	扬杰科技	600	17,160.00	0.09
319	002411	必康股份	604	17,117.36	0.09
320	300212	易华录	720	17,028.00	0.09
321	000989	九芝堂	900	17,010.00	0.09
322	002444	巨星科技	1,542	16,977.42	0.09
323	300101	振芯科技	1,200	16,956.00	0.09
324	002266	浙富控股	4,500	16,875.00	0.09
325	002716	金贵银业	1,000	16,840.00	0.09
326	000016	深康佳 A	3,200	16,800.00	0.09
327	002431	棕榈股份	2,500	16,775.00	0.09
328	000031	中粮地产	2,900	16,762.00	0.09
329	002250	联化科技	1,900	16,758.00	0.09
330	300666	江丰电子	300	16,539.00	0.09
331	002596	海南瑞泽	1,600	16,416.00	0.09
332	002128	露天煤业	1,800	16,308.00	0.09
333	000156	华数传媒	1,689	16,281.96	0.09
334	000666	经纬纺机	900	16,272.00	0.09
335	300207	欣旺达	1,800	16,218.00	0.09
336	300222	科大智能	873	16,185.42	0.09
337	002025	航天电器	700	16,170.00	0.09
338	002108	沧州明珠	2,738	16,072.06	0.09
339	300053	欧比特	1,376	15,961.60	0.09
340	300294	博雅生物	515	15,959.85	0.09
341	000507	珠海港	1,700	15,946.00	0.09
342	000933	神火股份	3,300	15,873.00	0.09
343	000006	深振业 A	2,700	15,822.00	0.09
344	000926	福星股份	2,200	15,818.00	0.09
345	000027	深圳能源	3,200	15,808.00	0.09
346	000723	美锦能源	2,900	15,747.00	0.09
347	002089	新海宜	2,600	15,730.00	0.09
348	002672	东江环保	1,200	15,708.00	0.09
349	300054	鼎龙股份	1,800	15,696.00	0.09
350	002390	信邦制药	2,143	15,686.76	0.09
351	002505	大康农业	7,300	15,622.00	0.09
352	300068	南都电源	1,300	15,574.00	0.09
353	002477	雏鹰农牧	4,700	15,557.00	0.09
354	002212	南洋股份	1,300	15,457.00	0.08
355	300459	金科文化	1,600	15,456.00	0.08
356	002056	横店东磁	2,200	15,422.00	0.08

357	000718	苏宁环球	4,200	15,414.00	0.08
358	300476	胜宏科技	1,000	15,400.00	0.08
359	300257	开山股份	1,000	15,290.00	0.08
360	002839	张家港行	2,500	15,225.00	0.08
361	002449	国星光电	1,430	15,215.20	0.08
362	000910	大亚圣象	900	15,210.00	0.08
363	002156	通富微电	1,400	15,162.00	0.08
364	002155	湖南黄金	2,200	15,048.00	0.08
365	000021	深科技	2,200	15,004.00	0.08
366	002402	和而泰	1,800	14,940.00	0.08
367	002389	南洋科技	1,100	14,894.00	0.08
368	300145	中金环境	1,900	14,877.00	0.08
369	300118	东方日升	1,371	14,806.80	0.08
370	002091	江苏国泰	2,300	14,605.00	0.08
371	002036	联创电子	1,100	14,432.00	0.08
372	000034	神州数码	900	14,382.00	0.08
373	002292	奥飞娱乐	1,600	14,288.00	0.08
374	002437	誉衡药业	2,300	14,260.00	0.08
375	000036	华联控股	2,400	14,256.00	0.08
375	000766	通化金马	1,200	14,256.00	0.08
377	002157	正邦科技	3,500	14,245.00	0.08
378	300002	神州泰岳	3,400	14,178.00	0.08
379	300078	思创医惠	1,483	14,058.84	0.08
380	000400	许继电气	1,800	14,058.00	0.08
381	002354	天神娱乐	1,508	13,964.08	0.08
382	002299	圣农发展	900	13,941.00	0.08
383	000563	陕国投 A	4,100	13,940.00	0.08
384	002773	康弘药业	267	13,886.67	0.08
385	000685	中山公用	1,740	13,867.80	0.08
386	000012	南玻 A	2,798	13,850.10	0.08
387	001965	招商公路	1,700	13,838.00	0.08
388	002055	得润电子	865	13,796.75	0.08
389	002668	奥马电器	683	13,728.30	0.08
390	000727	华东科技	7,300	13,724.00	0.08
391	002468	申通快递	800	13,720.00	0.08
392	000712	锦龙股份	1,369	13,662.62	0.07
393	002424	贵州百灵	1,200	13,632.00	0.07
393	300001	特锐德	1,200	13,632.00	0.07
395	002061	浙江交科	1,300	13,611.00	0.07
396	002249	大洋电机	3,155	13,598.05	0.07
397	002048	宁波华翔	1,100	13,563.00	0.07
398	300699	光威复材	300	13,560.00	0.07
399	002635	安洁科技	788	13,553.60	0.07
400	000980	众泰汽车	1,900	13,509.00	0.07

401	002400	省广集团	4,150	13,404.50	0.07
402	002421	达实智能	3,300	13,365.00	0.07
403	002123	梦网集团	1,500	13,335.00	0.07
404	300020	银江股份	1,400	13,314.00	0.07
405	000555	神州信息	1,000	13,280.00	0.07
406	002544	杰赛科技	953	13,046.57	0.07
407	002222	福晶科技	1,000	13,040.00	0.07
408	300323	华灿光电	1,000	12,920.00	0.07
409	002002	鸿达兴业	2,800	12,908.00	0.07
410	000155	川化股份	2,300	12,903.00	0.07
411	300038	梅泰诺	1,200	12,792.00	0.07
412	300353	东土科技	1,000	12,790.00	0.07
413	002237	恒邦股份	1,400	12,782.00	0.07
414	000937	冀中能源	3,100	12,741.00	0.07
415	300474	景嘉微	273	12,689.04	0.07
416	002073	软控股份	2,200	12,650.00	0.07
417	000553	沙隆达 A	800	12,648.00	0.07
418	002512	达华智能	1,300	12,610.00	0.07
419	002664	长鹰信质	500	12,550.00	0.07
420	000537	广宇发展	1,300	12,532.00	0.07
421	000088	盐田港	1,900	12,521.00	0.07
422	002251	步步高	1,100	12,518.00	0.07
423	300085	银之杰	961	12,473.78	0.07
424	000921	海信科龙	1,200	12,432.00	0.07
425	000587	金洲慈航	2,500	12,400.00	0.07
426	002242	九阳股份	700	12,383.00	0.07
427	002807	江阴银行	2,200	12,364.00	0.07
428	000667	美好置业	5,800	12,354.00	0.07
429	002047	宝鹰股份	2,100	12,306.00	0.07
430	000979	中弘股份	12,020	12,140.20	0.07
431	002143	印纪传媒	1,000	12,090.00	0.07
432	300083	劲胜智能	2,500	12,050.00	0.07
433	000789	万年青	1,100	12,034.00	0.07
434	000901	航天科技	1,200	12,024.00	0.07
435	000687	华讯方舟	1,300	11,973.00	0.07
436	000158	常山北明	1,730	11,885.10	0.07
437	000525	红太阳	700	11,865.00	0.07
438	002841	视源股份	220	11,750.20	0.06
439	002245	澳洋顺昌	1,800	11,646.00	0.06
440	000592	平潭发展	4,100	11,644.00	0.06
441	002308	威创股份	1,400	11,620.00	0.06
442	002303	美盈森	2,200	11,616.00	0.06
443	000762	西藏矿业	1,200	11,556.00	0.06
444	300431	暴风集团	760	11,536.80	0.06

445	000426	兴业矿业	1,600	11,536.00	0.06
446	002043	兔宝宝	1,500	11,490.00	0.06
447	000877	天山股份	1,700	11,475.00	0.06
448	002233	塔牌集团	1,000	11,440.00	0.06
449	002434	万里扬	1,300	11,414.00	0.06
450	002320	海峡股份	600	11,370.00	0.06
451	000061	农产品	2,100	11,340.00	0.06
452	000049	德赛电池	400	11,288.00	0.06
453	000990	诚志股份	800	11,200.00	0.06
453	002503	搜于特	3,200	11,200.00	0.06
455	000822	山东海化	1,600	11,152.00	0.06
456	002429	兆驰股份	4,492	11,140.16	0.06
457	002657	中科金财	700	11,088.00	0.06
458	002145	中核钛白	3,000	11,040.00	0.06
458	002608	江苏国信	1,600	11,040.00	0.06
460	002642	荣之联	1,200	11,028.00	0.06
461	002643	万润股份	1,450	10,831.50	0.06
462	002428	云南锗业	1,400	10,808.00	0.06
463	002670	国盛金控	1,001	10,780.77	0.06
464	002509	天广中茂	3,700	10,767.00	0.06
465	300134	大富科技	1,200	10,728.00	0.06
466	002542	中化岩土	2,000	10,680.00	0.06
467	300156	神雾环保	1,600	10,672.00	0.06
468	000539	粤电力A	2,500	10,600.00	0.06
469	002010	传化智联	872	10,594.80	0.06
470	000600	建投能源	1,900	10,583.00	0.06
471	300364	中文在线	1,500	10,560.00	0.06
472	002489	浙江永强	2,826	10,286.64	0.06
473	300273	和佳股份	1,500	10,170.00	0.06
474	300458	全志科技	566	10,142.72	0.06
475	000710	贝瑞基因	200	10,072.00	0.06
476	300075	数字政通	746	10,063.54	0.06
477	000062	深圳华强	500	9,800.00	0.05
478	002302	西部建设	900	9,693.00	0.05
479	002011	盾安环境	1,500	9,600.00	0.05
480	002482	广田集团	1,600	9,552.00	0.05
481	002681	奋达科技	1,100	9,526.00	0.05
482	000090	天健集团	1,520	9,424.00	0.05
483	002920	德赛西威	300	8,970.00	0.05
484	300310	宜通世纪	1,400	8,932.00	0.05
485	002625	光启技术	750	8,782.50	0.05
486	000959	首钢股份	2,100	8,631.00	0.05
487	002190	成飞集成	500	8,545.00	0.05
488	002522	浙江众成	1,300	8,411.00	0.05



489	000612	焦作万方	1,600	8,400.00	0.05
490	300317	珈伟股份	700	8,330.00	0.05
491	002261	拓维信息	1,800	8,280.00	0.05
492	300291	华录百纳	1,100	7,755.00	0.04
493	002648	卫星石化	700	7,721.00	0.04
494	002080	中材科技	900	7,650.00	0.04
495	000806	银河生物	1,755	7,599.15	0.04
496	000615	京汉股份	1,100	6,919.00	0.04
497	000564	供销大集	1,400	6,692.00	0.04
498	000987	越秀金控	844	6,633.84	0.04
499	300116	坚瑞沃能	2,400	6,624.00	0.04
500	002907	华森制药	200	5,614.00	0.03
501	000957	中通客车	800	5,472.00	0.03
502	000617	中油资本	400	4,496.00	0.02
503	002911	佛燃股份	200	4,466.00	0.02

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300601	康泰生物	47,132.00	0.23
2	000568	泸州老窖	44,918.00	0.22
3	000401	冀东水泥	43,871.00	0.22
4	000333	美的集团	33,286.00	0.16
5	002821	凯莱英	32,983.00	0.16
6	000932	华菱钢铁	29,601.00	0.15
7	002460	赣锋锂业	28,466.00	0.14
8	002262	恩华药业	28,330.00	0.14
9	002745	木林森	28,219.00	0.14
10	300618	寒锐钴业	26,900.00	0.13
11	300628	亿联网络	26,802.00	0.13
12	300347	泰格医药	26,475.00	0.13
13	000651	格力电器	24,916.00	0.12
14	000681	视觉中国	24,716.00	0.12
15	000858	五粮液	24,461.00	0.12
16	000423	东阿阿胶	23,202.00	0.11
17	300226	上海钢联	22,828.00	0.11
18	000528	柳工	22,440.00	0.11
19	002168	深圳惠程	22,132.00	0.11

20	300285	国瓷材料	21,685.00	0.11
----	--------	------	-----------	------

注：买入金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000651	格力电器	41,234.00	0.20
2	000568	泸州老窖	41,152.00	0.20
3	300750	宁德时代	32,505.00	0.16
4	000333	美的集团	30,535.00	0.15
5	002460	赣锋锂业	29,770.00	0.15
6	000858	五粮液	29,714.00	0.15
7	000423	东阿阿胶	29,678.00	0.15
8	002027	分众传媒	28,919.00	0.14
9	300137	先河环保	21,827.00	0.11
10	000661	长春高新	21,526.00	0.11
11	300203	聚光科技	21,148.00	0.10
12	000418	小天鹅A	20,793.00	0.10
13	300347	泰格医药	20,659.00	0.10
14	000002	万科A	19,301.00	0.10
15	300077	国民技术	18,011.00	0.09
16	000802	北京文化	17,865.00	0.09
17	002773	康弘药业	16,890.00	0.08
18	300474	景嘉微	16,261.00	0.08
19	002001	新和成	16,063.00	0.08
20	000901	航天科技	15,721.00	0.08

注：卖出金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,327,628.00
卖出股票收入（成交）总额	1,919,709.13

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 2018 年 2 月 7 日，大连银监局针对平安银行贷款资金转存款质押开立银行承兑汇票并在他行贴现，贴现资金回流转存款质押重复开立银行承兑汇票的违法事实，对平安银行处以人民币四十万元行政罚款。

2018 年 3 月 14 日，中国人民银行针对平安银行违反清算管理规定、人民币银行结算账户管理相关规定、非金融机构支付服务管理办法相关规定，给予警告，没收违法所得 3,036,061.39 元，并处罚款 10,308,084.15 元，合计处罚金额 13,344,145.54 元。

本基金为指数型基金，上述股票系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除平安银行外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案

调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	402.70
2	应收证券清算款	186,892.14
3	应收股利	-
4	应收利息	197.70
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	187,492.54

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中国银行股份有限公司 —易方达深证成指交易 型开放式指数证券投资 基金联接基金	
		持有份额	占总份	持有份额	占总份额	持有份额	占总份额

			额比例		比例		比例
191	100,549.97	16,506,428.00	85.95%	2,698,617.00	14.05%	16,255,528.00	84.64%

注：已包含场外持有人。机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国银行股份有限公司—易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	望华卓越（青岛）投资管理有限公司—望华卓越高分红价值成长私募证券投资基金	250,900.00	1.39%
2	包承宽	179,711.00	1.00%
3	赵勇	150,013.00	0.83%
4	苏明煜	141,800.00	0.79%
5	杨凤玲	132,612.00	0.74%
6	甘顺才	130,000.00	0.72%
7	汪南英	100,019.00	0.56%
8	张亚屏	95,001.00	0.53%
9	杨璐	90,000.00	0.50%
10	赵世增	80,015.00	0.44%
11	中国银行股份有限公司—易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	15,051,863.00	83.62%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例

基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%
------------------	------	---------

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年4月27日）基金份额总额	381,001,380.00
本报告期期初基金份额总额	18,001,380.00
本报告期基金总申购份额	1,561,020.00
减：本报告期基金总赎回份额	357,355.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	19,205,045.00

注：期末基金总份额包含场外份额 1,203,665 份；总申购份额包含场外总申购份额 1,561,020 份；总赎回份额包含场外总赎回份额 357,355 份。

### 10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

#### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2018 年 6 月 8 日发布公告，自 2018 年 6 月 8 日起聘任陈荣女士担任公司首席运营官（副总经理级），聘任汪兰英女士担任公司首席大类资产配置官（副总经理级）。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	1,555,175.00	36.77%	1,448.30	36.76%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-

长江证券	1	2,674,862.13	63.23%	2,491.13	63.24%	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少申万宏源证券有限公司一个交易单元,新增北京高华证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华创证券有限责任公司、瑞信方正证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、中泰证券股份有限公司、中信证券股份有限公司各一个交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------



	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	4,638.80	100.00%	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及	中国证券报、上海证券	2018-01-23

	时更新身份证件或者身份证明文件的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
2	易方达基金管理有限公司关于调整易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金场外份额在直销中心申购、赎回业务数额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-03-16
3	易方达基金管理有限公司关于易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金修订基金合同、托管协议部分条款的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-03-22
4	易方达基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-03-23
5	关于警惕冒用易方达基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-03-29
6	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2018-06-08

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
中国银行股份有限公司—易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2018年01月01日~2018年06月30日	13,645,790.00	2,868,538.00	258,800.00	16,255,528.00	84.64%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件和营业执照。

### 12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇一八年八月二十八日